

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

[連結:2020年6月末](別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式 の該当 番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年 6月末	2020年 3月末	2020年 6月末	2020年 3月末
1	信用リスク	2,783,326	2,682,173	235,629	227,049
2	うち、標準的手法適用分	33,806	34,018	2,704	2,721
3	うち、内部格付手法適用分	2,700,600	2,599,156	229,010	220,408
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	48,919	48,998	3,913	3,919
4	カウンターパーティ信用リスク	60,838	59,746	5,007	4,909
5	うち、SA - CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	20,500	22,308	1,738	1,891
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	25,536	27,398	2,042	2,191
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	6,075	5,411	486	432
	その他	8,725	4,628	739	392
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	402,662	373,565	34,145	31,678
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	279,478	249,613	23,699	21,165
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	1,455	-	116	-
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	107,240	105,341	8,579	8,427
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	107,240	105,341	8,579	8,427
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	154,773	154,773	12,381	12,381
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	154,773	154,773	12,381	12,381
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	10,917	26,882	920	2,273
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	3,800,693	3,652,096	320,479	307,885

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【連結：2020年6月末】(別紙様式第八号第二面)

(単位：百万円)

CR8: 内部格付手法を適用した信用リスク・エクスポージャーのリスク・アセット変動表			
項番		信用リスク・アセットの額	
1	前四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,036,249	
2	当四半期中の要因別 の変動額	資産の規模	207,292
3		ポートフォリオの質	△ 92,913
4		モデルの更新	-
5		手法及び方針	-
6		買収又は売却	-
7		為替の変動	-
8		その他	-
9	当四半期末時点における信用リスク・アセットの額	3,150,628	

(注記事項)

「資産の規模」の項には、「為替の変動」に起因する信用リスク・アセットの額の変動額を含めております。

自己資本比率告示の算式における分母の額に関する開示事項

【単体：2020年6月末】(別紙様式第八号第一面)

(単位：百万円)

OV1:リスク・アセットの概要					
国際様式 の該 当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2020年 6月末	2020年 3月末	2020年 6月末	2020年 3月末
1	信用リスク	2,773,442	2,672,121	234,982	226,391
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,730,723	2,629,556	231,565	222,986
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	42,719	42,565	3,417	3,405
4	カウンターパーティ信用リスク	60,838	59,746	5,007	4,909
5	うち、SA - CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	20,500	22,308	1,738	1,891
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	25,536	27,398	2,042	2,191
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	6,075	5,411	486	432
	その他	8,725	4,628	739	392
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	402,622	373,525	34,142	31,674
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	278,704	248,520	23,634	21,074
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	-	-	-	-
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	-	-	-	-
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	107,240	105,341	8,579	8,427
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	107,240	105,341	8,579	8,427
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	-	-	-	-
16	マーケット・リスク	-	-	-	-
17	うち、標準的方式適用分	-	-	-	-
18	うち、内部モデル方式適用分	-	-	-	-
19	オペレーショナル・リスク	146,058	146,058	11,684	11,684
20	うち、基礎的手法適用分	-	-	-	-
21	うち、粗利益配分手法適用分	146,058	146,058	11,684	11,684
22	うち、先進的計測手法適用分	-	-	-	-
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	8,739	15,796	741	1,339
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計	3,777,646	3,621,111	318,771	305,501